สารบาญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบาญตาราง	ญ
สารบาญภาพ	ฎ
สารบาญตารางภาคผนวก	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มา และความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	6
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	6
1.4 ขอบเขตการศึกษา	7
1.5 นิยามศัพท์	7
บทที่ 2 กรอบแนวคิดทางทฤษฎีและเอกสารที่เกี่ยวข้อง	
2.1 กรอบแนวคิดทางทฤษฎี	
1) ทฤษฎีการลงทุน	9
2) ความสัมพันธ์ระหว่างการลงทุนกับอัตราดอกเบี้ย	9
3) รายจ่ายเพื่อการลงทุน	9
4) ทฤษฎีโครงสร้างของตลาดอุตสาหกรรม	15
5) ทฤษฎีการทดสอบ Unit Root	15
6) ทฤษฎีแบบจำลอง Autoregressive integrated moving average model (ARIMA)	17
2.2 เอกสารที่เกี่ยวข้อง	20

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

บทที่ 3 ระเบียบวิธีการวิจัย
3.1 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา 27
3.2 วิธีการวิเคราะห์ข้อมูล 27

บทที่ 4 ผลการศึกษาและการวิเคราะห์ข้อมูล
4.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล
1) ผลการทดสอบ Unit Root 29
4.2 กำหนดรูปแบบด้วยแบบจำลองอารีแม็กซ์
1) กำหนดแบบจำลอง Identification 31
2) ผลการวิเคราะห์แบบจำลอง ARIMAX 31
4.3 ศึกษาปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลต่อการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศ
ในอุตสาหกรรมอาหารของประเทศไทย 33
4.4 การพยากรณ์การลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศในอุตสาหกรรมอาหาร
ของประเทศไทย 36

บทที่ 5 บทสรุปและข้อเสนอแนะ
5.1 สรุป 39
5.2 ข้อเสนอแนะและข้อจำกัดในการศึกษา
1) ข้อเสนอแนะในการศึกษาครั้งต่อไป 41
2) ข้อจำกัดในการศึกษา 41

เอกสารอ้างอิง 43

ภาคผนวก
ภาคผนวก ก ผลการประเมินแบบจำลอง ARIMAX ด้วยโปรแกรม Eviews 6.0 46

ประวัติผู้เขียน 57

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบาญตาราง

ตาราง **หน้า**

1.1 เปรียบเทียบปริมาณเงินลงทุนโดยตรงสุทธิจากต่างประเทศในภาคอุตสาหกรรมทั้งหมดต่อภาคอุตสาหกรรมอาหาร ปี พ.ศ. 2541-2551 4

1.2 สัดส่วนมูลค่าการส่งออกของภาคอุตสาหกรรมอาหารกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศไทย ปี พ.ศ. 2541-2551 5

4.1 แสดงผลการทดสอบ Unit Root โดยวิธี Augmented Dickey-Fuller (ADF) 30

4.2 แสดงผลค่าพารามิเตอร์และค่า t-Statistics โดยแบบจำลอง 4.1 32

4.3 แสดงผลการคำนวณ R-squared, Adjusted R-squared และ F-Statistics 32

4.3 แสดงผลของการทดสอบ Serial Correlation 33

4.4 แสดงผลการพยากรณ์เงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศในอุตสาหกรรมอาหารของประเทศไทย จากแบบจำลองสมาการที่ 4.2 และการพยากรณ์เงินลงทุนล่วงหน้า 4 ช่วงเวลา 38

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบาญภาพ

รูป **หน้า**

2.1 ความสัมพันธ์ระหว่างการลงทุนกับอัตราดอกเบี้ย 10
2.2 แสดงการลงทุนที่ขึ้นกับรายได้ประชาชาติ 13
2.3 แสดงการกำหนดปริมาณลงทุนของหน่วยธุรกิจ 14
4.1 แสดงผลพยากรณ์เงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศในอุตสาหกรรมอาหารของประเทศไทย 37
4.2 แสดงผลพยากรณ์เงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศในอุตสาหกรรมอาหารของประเทศไทย ใน 4 ช่วงเวลาข้างหน้า 37

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบาญตารางภาคผนวก

ตาราง	หน้า
1 ก การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของเงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศ	46
2 ก การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของดัชนีผู้บริโภค	47
3 ก การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของดัชนีผลผลิตอุตสาหกรรม	49
4 ก การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	50
5 ก การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของอัตราดอกเบี้ยเงินกู้ (MLR)	52
6 ก การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของมูลค่าการส่งออกอาหาร	53
7 ก ผลการทดสอบจากแบบจำลอง ARIMAX	55
7 ก ผลการทดสอบจากแบบจำลอง ARIMAX (ต่อ)	56
8 ก ผลการทดสอบ Autocorrelation	56

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved